

AMX -Storebrand -Global ESG Plus

2023-01-01

Samenvatting

AMX - Storebrand - Global ESG Plus bevordert milieu- en maatschappelijke kenmerken, maar heeft duurzaam beleggen niet als doel. Ten minste 80% van de activa is afgestemd op de bevorderde kenmerken, waaronder minimaal 30% duurzame beleggingen. Andere activa bestaan uit contanten en dergelijke voor liquiditeitsbeheer. Alle onderliggende effecten worden beoordeeld op hun nadelige impact als onderdeel van een 'do no significant harm'-proces (DNSH).

Het Fonds bevordert milieukenmerken door actief te beleggen in bedrijven die bijdragen aan de mitigatie van klimaatverandering en/of andere positieve effecten kunnen hebben op milieu en maatschappij door bepaalde bedrijven die een negatieve impact hebben op het milieu en/of de samenleving uit te sluiten. Het Fonds bevordert maatschappelijke kenmerken door bedrijven uit te sluiten die een negatieve impact kunnen hebben op de samenleving en die internationale normen overtreden. Dit omvat het integreren van ESG-aspecten (milieu, maatschappij en corporate governance) in alle beleggingen.

Het Subfonds streeft ernaar de kenmerken te bereiken door beleggingen te richten op bedrijven met hoge ESG-scores, lage koolstofintensiteit en klimaatoplossingen. Ook is het Subfonds onderworpen aan een uitsluitingsstrategie om blootstelling te vermijden in bedrijven die een negatieve impact hebben op uiteenlopende milieu- en maatschappelijke doelstellingen.

Naast de methoden om sommige ondernemingen waarin wordt belegd actief te selecteren (inclusie) en anderen te vermijden (exclusie), houdt de Beleggingsbeheerder in belang van het Subfonds ook rekening met duurzaamheidsgerelateerde kwesties. Betrokkenheid kan de vorm aannemen van een directe dialoog met de portefeuilledeelneming, samenwerking met andere beleggers of door te stemmen op aandeelhoudersvergaderingen.

De volgende duurzaamheidsindicatoren worden gebruikt om de verwezenlijking van de milieu- en maatschappelijke kenmerken van het Subfonds te beoordelen:

- *Storebrand ESG-duurzaamheidsscore*
- *Aandeel van groene inkomsten*
- *Koolstofintensiteit scope 1 en 2*
- *PAI 4. Blootstelling aan bedrijven die actief zijn in de fossiele-brandstofsector*
- *PAI 10. Overtreding van de principes van het Global Compact van de VN en de richtlijnen van de Organisatie voor Economische Samenwerking en Ontwikkeling (OESO) voor multinationale ondernemingen*
- *PAI 14. Blootstelling aan controversiële wapens (antipersoonsmijnen, clustermunities, chemische wapens en biologische wapens)*
- *Inkomsten uit bedrijfsactiviteiten die verband houden met de productie en distributie van kernwapens, wapens, alcohol, tabak, cannabis, pornografie en commercieel gokken.*

Het Fonds past doorlopende follow-up toe op holdingniveau om ervoor te zorgen dat bedrijven met activiteiten in door het Fonds uitgesloten sectoren en/of bedrijven die internationale normen en conventies overtreden, worden geïdentificeerd. Dit betekent dat er informatie over elk afzonderlijk bedrijf in het Fonds wordt verkregen van onze gegevensleveranciers. In geval van een wijziging in de beoordeling van een onderneming, wordt deze gemarkeerd in de doorlopende monitoring van het Fonds, wordt de informatie gevalideerd door de Beheerder en wordt de onderneming uitgesloten van het Fonds als de informatie correct is.

Gegevens worden voornamelijk verzameld bij de externe gegevensverstrekkers Sustainalytics, ISS en Trucost. Storebrand heeft deze aanbieders gekozen omdat wij hen beschouwen als toonaangevende aanbieders van gegevens en analyses van ESG- en duurzaamheidsanalyses voor bedrijven. Zij leveren gegevens en analyses over ESG-risico's, corporate governance, controverses, landenrisicobeoordelingen, productbetrokkenheid en meer.

De indicatoren voor de belangrijkste negatieve impact worden verantwoord op basis van de gegevensbeschikbaarheid van de onderliggende effecten. De belangrijkste beperkingen zijn het ontbreken van gegevens voor sommige indicatoren. Dit komt doordat veel bedrijven deze informatie niet openbaar maken. Over het algemeen is er een lage dekking van de gerapporteerde gegevens van de bedrijven in vergelijking met de geschatte gegevens en tot op zekere hoogte afhankelijk van de PAI.

De Beleggingsbeheerder beschikt over due diligence-procedures om ervoor te zorgen dat er bij de beleggingsbeslissingen rekening wordt gehouden met duurzaamheidsrisico's en de duurzaamheidsvereisten die voor het Fonds zijn vastgesteld. Onze due diligence-procedure bestaat uit een screening van onze deelnemingen die elk kwartaal wordt uitgevoerd. De screening op overtreding van onze Sustainable Investment Policy wordt uitgevoerd met behulp van gegevens van onze externe gegevensverstrekkers, die ongeveer 4.000 bedrijven in ons beleggingsuniversum monitoren.

Storebrand gebruikt zet de eigenaarspositie in om bedrijven aan te sporen hun gedrag te verbeteren en negatieve duurzaamheidseffecten te verminderen. Door actief eigenaarschap verminderen wij risico's, verbeteren de kwaliteit van onze beleggingen en stimuleren wij bedrijven om duurzamer te handelen.

Storebrand denkt niet dat één methode alles kan oplossen, maar gelooft in een combinatie van dialoog, uitsluiting, inclusie en integratie.

Er is geen referentiebenchmark aangewezen om de door het Subfonds bevorderde milieu- en maatschappelijke kenmerken te bereiken.